

Title	差分方程式と微分方程式(群と微分方程式の数式処理システムの研究)
Author(s)	福原, 満州雄
Citation	数理解析研究所講究録 (1988), 663: 62-76
Issue Date	1988-07
URL	http://hdl.handle.net/2433/100627
Right	
Type	Departmental Bulletin Paper
Textversion	publisher

差分方程式と微分方程式

福原満洲雄 (Masuo Hukuhara)

1. 序論

線形差分方程式の解の漸近展開については, Poincaré 以来, 不確定特異型線形微分方程式と類似な結果が得られているが, 必ずしも理解し易くはなっていない. また, 単に類似性に注目するだけでは物足りない.

例えば, Mellin 変換——積分変数を変更するだけで Laplace 変換になるから, これを Laplace 変換という著者もいる——によって差分方程式の解と微分方程式の解とが対応することも既知であるが, それを利用して解の性質をどこまで追求できるのか, 文献に暗いのでよく分らない. もっと後学のため, というのは必ずしも後進のためというわけではなく, 自分をも含めて, さらに微分方程式の理論を発展させるために重要になると思われる知識を広め, かつ高めるために, 差分方程式の理論をもっと近づき易いものとして建設しておくべきであると思う.

高階代数的微分方程式の中で、その一般解が動く分岐点をもたないものを求めるという問題設定が良いか悪いかということではなく、Painlevé を初めとする後続の学者の努力はそれなりに高く評価されるべきであらうことはいうまでもない。しかし最初から、 Γ 関数が、代数的微分方程式の解にならない——このことは吉江琢児先生の東大での講義でも説明されており、周知の事実であった——ということのためには、このような関数の研究が対象から外されていたように感じを受けたが、このことは自分は多少の疑問を抱いた。

よく知られているように、それが満たす関係式

$$\Gamma(x+1) = x\Gamma(x)$$

は簡単な差分方程式の一例である。それが何故に微分方程式の解である特殊関数の解析的研究に不可欠となるのか、その理由を解明すべきであったと思う。例えば、Gauss の微分方程式の解の接続公式の中にはこの Γ 関数が現れるが、その理由は Γ 関数が簡単な差分方程式の解だからである。

一方、微分方程式の一般解が動く分岐点をもたないという条件から微分方程式を決定することは多くの困難を伴うのに反して、有理関数を係数とする差分方程式が有理型関数解をもつことが大した困難なしに証明される。しかも、そのような関数が線形微分方程式の解の接続公式の中に現れる、とい

う事実を見逃してはなるまい。

また、モノドロミ不変の線形微分方程式と動く分岐点とを
たない非線形微分方程式との関係が R. Fuchs 等によって注意
された。もし接続公式が求まれば、それからモノドロミ不変
の条件も書き下せる。差分方程式について知られた事実を微
分方程式に応用することによって未知の事実が解明されるこ
とがあってもよいのではないか。少なくとも現在は、このよう
な方向での研究は初期の段階と思われるから、こゝで深く立
入ることはできないので、単に問題提起に止めておく。

2. 正則型, 確定特異型, 不確定特異型

連立差分方程式は、行列記号を使って、

$$y(x+1) = A(x)y(x)$$

のように書かれることが多い。 $A(x)$ は ∞ を極あるいは正則
点とする $n \times n$ 行列である。

$$y(x) = \Gamma(x)^m z(x)$$

とおけば、これは

$$z(x+1) = x^{-m} A(x) z(x)$$

に変形されるから、 $A(x)$ の ∞ における極の位数などは大し
な意味をもたない。差分記号

$$\Delta y(x) = y(x+1) - y(x)$$

を使って、差分方程式を

$$x \cdot \Delta y(x) = A(x) y(x)$$

のように書く方がよい。ここで $A(x)$ は、 x において $x^{1/q}$ (q は正の整数) の関数として、正則 または 有理型 とする。
微分方程式の場合には、必要なら $x^{1/q}$ を改めて独立変数にとって、いつでも $q=1$ の場合に帰着させることが出来るが、差分方程式の場合にはそうはいかない。

そこで、 $A(x)$ は $x^{1/q}$ (q は或る正の整数) の関数として x を正則点または極とし、そのべき級数展開を

$$(2) \quad A(x) = \sum_{v=0}^{\infty} x^{-v/q} A_v$$

とする。(1) は $\sigma > 0$ なら 正則型、 $\sigma = 0$ なら 確定特異型、 $\sigma < 0$ なら 見掛上不確定特異型 である。見掛上というのは、有理関数を係数とする線形変換で外見的に確定特異型に変形されることがあるからである。そうでないとき 真性特異型 というべきであるが、便宜的に '見掛上' '真性' を省略して単に 不確定特異型 という。

形式的べき級数

$$(3) \quad P(x) = P_0 + x^{1/q} P_1 + \dots + x^{v/q} P_v + \dots$$

を係数とする線形変換

$$(4) \quad y = P(x) z$$

で (1) を出来るだけ簡単にする操作は微分方程式の場合と

全く同様で、説明を要しない。ここで q' は正の整数で、正則型、確定特異型の場合には $q'=q$ であるが、不確定特異型の場合は $q'=q$ ととれるとは限らない。

線形変換 (4) の逆変換

$$z = P^{-1}(x)y$$

も考えから、 $\det P(x) \neq 0$ を仮定するのは当然であるが、 $\det P_0 \neq 0$ とは限らない。

3. 標準型

前述のようにして、(1) をできるだけ簡単にした差分方程式を (1) の標準型という。(1) が正則型か、確定特異型、不確定特異型かに従って、その標準型は次のようになる。

$$(5)_0 \quad \Delta z(x) = 0,$$

$$(5)_1 \quad x \cdot \Delta z(x) = (\Lambda + E)z(x),$$

$$(5)_2 \quad x \cdot \Delta z(x) = (\Lambda(x) + E)z(x).$$

ここで

$$(6)_1 \quad \Lambda + E = (\mu_1 I_1 + E_1) \oplus \cdots \oplus (\mu_m I_m + E_m),$$

$$(6)_2 \quad \Lambda(x) + E = (\mu_1(x) I_1 + E_1) \oplus \cdots \oplus (\mu_m(x) I_m + E_m);$$

I_j は単位行列、 E_j は上三角行列の直和、その次元はそれぞれ n_j ($n_1 + \cdots + n_m = n$)、 $\mu_j(x)$ は $x^{1/q'}$ の多項式で、 $j \neq k$ のとき $\mu_j(x) \not\equiv \mu_k(x) \pmod{1}$ である。1次元の上三角行列は零行列を意味する。

標準型の差分方程式の解を(4)に入れることにより

(1)の形式解を得る。(5)₀については説明を要しない。

(5)₁は(5)₂において $\Lambda(x)$ が定数になった場合とみなせるから、(5)₂について考える。

(5)₂は各 j 毎に1組の連立差分方程式になっているから、 j を省略して、

$$(7) \quad x \cdot \Delta z(x) = (\mu(x)I + E)z(x)$$

において E がレフト行列の直和であるとする。ところで、 E を構成する一つのレフト行列に關係のある $z_j(x)$ だけ集めると、それらだけで1組の差分方程式となるから、(7)において E がレフト行列、即ち対角線のすぐ上だけが1で、他の要素がすべて0、という場合を考えればよい。

E の次元を n とし、(7)を成分の式に書直せば、

$$(8) \quad \begin{cases} x \cdot \Delta y_j(x) = \mu(x)y_j(x) + y_{j+1}(x) & (j < n) \\ x \cdot \Delta y_n(x) = \mu(x)y_n(x) \end{cases}$$

となる。この最後の式を満たす関数 $f(x)$ をとれば、

$$(9) \quad x f(x+1) = (\mu(x) + x) f(x).$$

この $f(x)$ は和分によって求められる。そこで

$$(10) \quad \begin{cases} y_j(x) = f(x) u_j(x) & (j < n) \\ y_n(x) = f(x) u_n(x) \end{cases}$$

とおけば、

$$(11) \begin{cases} (\mu(x) + x) \Delta u_j(x) = u_{j+1}(x) & (j < n) \\ \Delta u_n(x) = 0 \end{cases}$$

となるから, $\mu_{n-1}(x), \dots, \mu_1(x)$ の順にそれぞれは積分を行う
ことにより求まる。

4. Mellin 変換

Mellin 変換によって, 微分方程式の解と差分方程式の解
との対応がはつきり分るのは確定特異型の場合である。

$$(11) \quad A(x)y(x+1) = B(x)y(x)$$

において, $A(x), B(x)$ が共に m 次の多項式で, $n \times n$ 行列
であるとする。従って

$$(12) \quad A(x) = \sum_{k=0}^m x^k A_k, \quad B(x) = \sum_{k=0}^m x^k B_k$$

と書ける。Mellin 変換は

$$(13) \quad y(x) = \int_L t^{x-1} \eta(t) dt$$

で与えられる。

積分の道 L は, 部分積分を行って

$$(14) \quad x^k y(x) = (-1)^k \int_L t^{x-1} \delta^k \eta(t) dt$$

に成立つようにとる δ は微分作用子 $t, d/dt$ を意味する。
従って, (11) に対応する微分方程式は

$$(15) \quad \sum_{k=0}^m (-1)^k \{A_k \mathcal{D}^k [\tau \eta(t)] - B_k \mathcal{D}^k \eta(t)\} = 0$$

と書ける.

(15) において最高階の導関数 $\eta^{(m)}(t)$ の係数は $\tau^m(\tau A_m - B_m)$ であるから, その特異点 ($\neq \infty$) は τ に関する方程式

$$(16) \quad \tau^m \det(\tau A_m - B_m) = 0$$

の根である. 今後, 特殊な条件が成立する場合を除いて考えることにし, 予め定係数の線形変換を行って,

$$(17) \quad A_m = I, \quad B_m = \Lambda = \text{diag}[\lambda_1, \dots, \lambda_m],$$

$0, \lambda_1, \dots, \lambda_m$ は相異なるとする. それらが (15) の特異点である.

(15) は, $\eta(t)$ が n ベクトルであるから, $\mathcal{D}^k \eta(t)$ ($k = 0, 1, \dots, m-1$) の成分に関する mn 階の連立線型微分方程式である.

一般に, N 連立 1 階線形微分方程式が確定特異点 λ において $N-1$ 個の正則な解をもつ, λ の λ における値の行列の階数が $N-1$ で, 残る一つの解が非整お λ を指数とすると, λ を 単純な確定特異点, λ をそこにおける 特性指数, λ を指数とする解を λ における 重要解 という.

この定義によれば, $\lambda_1, \dots, \lambda_m$ は (15) の単純な確定特異点であり, λ_j における特性指数を κ_j とすれば, $A_{m-1} -$

$\lambda_j^{-1} B_{m-1}$ の j 番目の対角線要素が $K_j + m$ である。

(15) には, その単純な確定特異点において主要解が存在する。そのべき級数展開から, Mellin 変換によって, それらに対応する (11) の解の漸近行動を知ることが出来る。

5. Mellin 積分と Riemann-Liouville 積分

Mellin 変換 (13) を Fuchs 型微分方程式に適用すると, L は $\eta(t)$ の単純な確定特異点入をやはり確定特異点である 0 または ∞ — そこでは正則解が存在しないとする — を両端とする曲線があるが, 簡単のため L は $0, 1$ を両端とする線分とする。このとき, 1 は単純な確定特異点 — そこにおける特性指数 ν を K — とし, この K を明示するため, 主要解を

$$(16) \quad f_K(t) = (1-t)^K f(t)$$

と書く。従って, $f(t)$ は $0, 1$ を両端とする線分上で, 0 を除けば正則, 0 はその確定特異点である。

$f(t)$ の 1 における Taylor 展開を

$$(17) \quad f(t) = f_0 + (1-t)f_1 + \cdots + (1-t)^\nu f_\nu + \cdots$$

と書き, 記号

$$(y)_\nu = y(y+1)\cdots(y+\nu-1)$$

を使い, したがって形式的には, $f_K(t)$ の Mellin 積分

$$(19) \quad \varphi_K(x) = \frac{1}{\Gamma(x)} \int_0^1 t^{x-1} f_K(t) dt$$

と $\Gamma(x+K+1)/\Gamma(K+1)$ との積は、 $x+K$ の逆階乗級数として

$$(20) \quad \frac{\Gamma(x+K+1)}{\Gamma(K+1)} \varphi_K(x) = \sum_{v=0}^{\infty} \frac{(K+1)_v}{(x+K+1)_v} f_v$$

のように表される。

一般に、 a からの R-L 積分 は

$$(21) \quad I_a^{\rho} f_K(x) = \frac{1}{\Gamma(\rho)} \int_a^x (x-t)^{\rho-1} f_K(t) dt$$

で定義される。これは ρ の整関数である。

a を 1, x を 0, ρ を x とし、積分の上限と下限を入れ換えると、符号は反対になるが、本質的には Mellin 積分となる。このことから、 $f(x)$ の正則点で $\varphi(x)$ も正則、確定特異点では $\varphi(x)$ も確定特異点をもつことが分る。

逆階乗級数は $\operatorname{Re} x$ が収束座標より大きい範囲——これは収束半平面である——で正則であり、そこで漸近展開になっている。 x を σx で置換えたりするににより、収束半平面の境界線である直線が虚軸と交わるようにもできるし、漸近展開が有効な範囲を広げることでもある。

$f(t)$ の 1 における Taylor 展開の特異度——Hadamard が導入した Taylor 級数の Ordre——と $\varphi(x)$ を表す逆階

束級数の収束座標との間にも顕著な関係がある。

このように、差分方程式の場合には、解の性質を知る上で、逆階束級数展開が適していることを物語る。

6. Euler 変換

超幾何型微分方程式

$$(22) \quad (x-\Lambda) dy/dx = Ay$$

においては、 A は $n \times n$ 行列、 Λ は対角行列

$$(23) \quad \Lambda = \text{diag}[\lambda_1, \dots, \lambda_n]$$

で、何れも定数行列である。これに Euler 変換

$$(24) \quad z(x) = D^{\rho} y(x)$$

を行うということは、(22) に同種の微分方程式

$$(25) \quad (x-\Lambda) dz/dx = (A-\rho)z$$

を対応させることである。 $\rho = \nu$ が正の整数なら、 D^{ν} は ν 回微分子となる。 $\rho = -\nu$ が負の整数なら、 $D^{-\nu}$ ———— これを I^{ν} とも書く ———— ν 回積分子である。

この作用子に関して基本公式

$$D^{\alpha} D^{\beta} = D^{\alpha+\beta}$$

が成立つことはよく知られている。もちろん、 D^0 は恒等写像子である。

Painlevé が彼の名で呼ばれる微分方程式の型を決定したとき、元の方程式にはない助変数を導入したが、その方法は

巧妙であった。ここでの問題はそれとは性格が異なるが、超幾何型微分方程式の解の性質を知るため新しい助変数を導入するとしたら、Euler 変換子 DP が含む p を助変数とみなすのがよからう。実際は p が正の整数なら、モノドロミ群は変化しない。一般には p の任意の値に対してモノドロミ群がどう変化するか。さらに一般化して、解の接続公式が p と共にどう変化するかを知ることはより、接続係数が p の如何なる関数かを知ることからできるか。大域的問題をこのように従えるのも一つの案であろう。

そこで、(22) の解と (24) の解との対応を明らかにせねばならない。

$\lambda_1, \dots, \lambda_m$ は互に異なるとすれば、(22), (24) の何れにおいても有限の特異点は単純である。 λ_j における (22), (24) の主要解を $\eta_j(x)$, $\zeta_j(x)$ とすれば、これらの対応関係は

$$(26) \quad \eta_j(x) = \frac{1}{\Gamma(p)} \int_{\lambda_j}^x (x-t)^{p-1} \zeta_j(t) dt,$$

$$(27) \quad \zeta_j(x) = \frac{1}{\Gamma(p)} \int_{\lambda_j}^x (x-t)^{p-1} \eta_j(t) dt$$

で与えられる。

このような積分に関する結果を見易くするため

$$f_\alpha(x) = x^\alpha f(x)$$

$f(x)$ は $x=0$ で 0 とはならない正則関数とし, その Macclaurin 展開を

$$f(x) = f_0 + x f_1 + \cdots + x^{\nu} f_{\nu} + \cdots$$

とする. その R.-L 積分

$$I_{\nu}^{\rho} f_{\alpha}(x) = \frac{1}{\Gamma(\rho)} \int_0^x (x-t)^{\rho-1} f(t) dt$$

は $x=0$ で正則な関数

$$F_{\alpha}(x) = \sum_{\nu=0}^{\infty} x^{\nu} \frac{(\alpha+1)_{\nu}}{(\rho+\alpha+1)_{\nu}} f_{\nu}$$

と $\Gamma(\alpha+1)/\Gamma(\rho+\alpha+1)$ との積となる. この係数が $\rho+\alpha$ の逆階乗という特徴をもっていることが重要である.

E を $f(x)$ の 0 を中心とする星状正則域—— 0 , x を結ぶ閉線分上で $f(x)$ が正則であるような x の集合——とすれば, $F_{\alpha}(x)$ も E で正則である. この他にも注目すべき関係が見出される.

7. 接続行列が満たす差分方程式

$x = \lambda_j$ における (24) の主要解を $\varphi_j(x, \rho)$ で表し, それらで作られる行列——標準基本解行列——を

$$(28) \quad \Phi(x, \rho) = [\varphi_1(x, \rho), \dots, \varphi_n(x, \rho)]$$

とする.

一つの特異点, 例えは λ_n , における 局所標準基本解行列

を

$$(29) \quad \Psi(x, \rho) = [\psi_1(x, \rho), \dots, \psi_n(x, \rho)]$$

とす。ここで $\psi_n(x, \rho) = \varphi_n(x, \rho)$ で、 $\psi_1(x, \rho), \dots, \psi_{n-1}(x, \rho)$ は λ_n における正則解で、 λ_n における値 $\psi_j(\lambda_n, \rho)$ は ψ_j 成分だけが 1、 ψ_n 成分を除いて他の成分は 0 という条件で与えられる。 $\Psi(x, \rho)$ に対して $\Phi(x, \rho)$ を 大域標準基本解行列 という。 $\Phi(x, \rho)$ と $\Psi(x, \rho)$ の間には線形関係

$$(30) \quad \Phi(x, \rho) = \Psi(x, \rho) C(\rho)$$

が成立つ。この接続係数 $C(\rho)$ を知ることによって、 λ_n をまわす回路に沿って解析接続したとき、 $\Phi(x, \rho)$ がどんな変化をするかが分る。

ところが、 $C(\rho)$ は線形関係式

$$(31) \quad C(\rho-1)(A+\rho) = B(\rho)C(\rho)$$

を満たす。ここで

$$(32) \quad \begin{cases} A = \text{diag}[a_{11}, \dots, a_{nn}] \\ b_{jk}(\rho) = \begin{cases} \frac{1}{\lambda_n - \lambda_k} \left\{ a_{kk} + \rho - \frac{a_{k1}a_{1k}}{\rho + a_{nn}} \right\} & (j=k) \\ \frac{1}{\lambda_n - \lambda_j} \left\{ a_{jk} - \frac{a_{jn}a_{nk}}{\rho + a_{nn}} \right\} & (j \neq k) \end{cases} \end{cases}$$

である。さらに

$$(33) \quad C(\rho) = D(\rho) \Gamma(A + \rho + 1)$$

とおけば、 $D(p)$ の係数が $u(p)$ に関する差分方程式

$$(34) \quad u(p-1) = B(p)u(p)$$

の解となる。これを(11)のように書けば、左辺の係数は1次式、右辺の係数は2次式となって、そこで述べた一般論がそのまま適用できるわけではないうが、これは特殊な差分方程式として研究の対象となり得るであろう。

$p + a_{nn}$ を両辺に掛けて、分母を払い、左辺の係数の行列式を0とおけば、 $p = -a_{nn}$ が n 重根、右辺の係数の行列式を0とおけば、その根は定数行列 A の固有値の符号を変えたものである。

複素関数論において、有理型関数に関してどの程度の成果が得られているのかよく知らないが、ここに現れる有理型関数解は、その位数が1であり、その特異点の分布も合っているのである。

しかし、解というのはベクトル値関数である。また、接続行列も考えよなら、それは行列値関数である。そのとき、零点に対応する点を正常な正則点として扱うのは適切でない。そこには複素関数論的立場から新たな理論を展開する必要があると思われる。

以上、雑駁な話に終止したが、その中から将来新しい何物かが生れ出ることを期待したいものである。